

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ  
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ  
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
«РЯЗАНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ИМЕНИ С.А. ЕСЕНИНА»

Утверждаю:  
Декан факультета экономики

 В.С. Отто

«31» августа 2020 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

**Управление корпоративными рисками**

Уровень основной профессиональной образовательной программы: *магистратура*

Направление подготовки: *38.04.01 Экономика*

Направленность (профиль) подготовки *Финансовая экономика*

Форма обучения: *заочная*

Сроки освоения ОПОП: *нормативный, 2,5 года*

Факультет: *экономики*

Кафедра: *бухгалтерского учета, налогообложения и экономического анализа*

Рязань, 2020

## **ВВОДНАЯ ЧАСТЬ**

### **1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ**

Целью изучения дисциплины является формирование у обучающихся компетенций, обеспечивающих получение профессиональных умений и навыков идентификации, оценки и управления рисками корпорации.

### **2. МЕСТО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВУЗА**

**2.1.** Учебная дисциплина «Управление корпоративными рисками» относится к дисциплинам по выбору вариативной части Блока 1.

**2.2.** Для изучения данной учебной дисциплины необходимы следующие предшествующие дисциплины:

- Микроэкономика (продвинутый уровень)
- Макроэкономика (продвинутый уровень)

**2.3.** Перечень последующих учебных дисциплин, для которых необходимы знания, умения, владение, формируемые данной учебной дисциплиной:

- Стратегическое управление
- Анализ банкротств и антикризисное управление
- Финансовый менеджмент

## 2.4. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения основной профессиональной образовательной программы

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся общепрофессиональных (ОПК) и профессиональных (ПК) компетенций:

| № п/п | Номер/индекс компетенции | Содержание компетенции (или ее части)  | Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине<br>В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны:  |   |   |
|-------|--------------------------|--|--|---|---|
|       |                          |  | Знать  | Уметь   | Владеть   |
| 1     | 2                        | 3  | 4  | 5   | 6   |
| 1.    | ОПК-3                    | Способностью принимать организационно-управленческие решения   | <ul style="list-style-type: none"> <li>- специфику рисков деятельности корпораций</li> <li>- особенности классификации корпоративных рисков и методы их измерения</li> <li>- методы управления корпоративными рисками</li> </ul>         | <ul style="list-style-type: none"> <li>- находить, распознавать и описывать природу риска</li> <li>- определять уровень риска</li> <li>- определять направления модификации риска</li> </ul>  | <ul style="list-style-type: none"> <li>- навыками анализа отчетности и операционной деятельности компании с целью идентификации рисков</li> <li>- навыками анализа коммерческой деятельности компании с целью анализа риска и своевременного принятия организационно-управленческого решения</li> </ul> |
| 2.    | ПК-12                    | Способностью разрабатывать варианты управленческих решений и обосновывать их выбор на основе критериев социально-экономической эффективности | <ul style="list-style-type: none"> <li>- принципы управления рисками</li> <li>- концепцию и процесс управления рисками</li> <li>- методы мониторинга и анализа принятых управленческих решений в области корпоративных рисков</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>- количественно и качественно оценивать подверженность корпорации риску</li> <li>- строить карту рисков</li> <li>- оценивать степень риска принимаемых в корпорациях управленческих решений</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>- навыками разработки карты рисков корпорации</li> <li>- навыками выбора метода снижения корпоративных рисков и обоснования этого выбора на основе критериев социально-экономической эффективности</li> </ul>  |

## 2.5 Карта компетенций дисциплины

| КАРТА КОМПЕТЕНЦИЙ ДИСЦИПЛИНЫ  |  |  |   |                           |   |
|---|--|--|---|---------------------------|---|
| НАИМЕНОВАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ Управление корпоративными рисками                         |  |  |   |                           |   |
| Цель дисциплины   |  | Целью изучения дисциплины является формирование у обучающихся компетенций, обеспечивающих получение профессиональных умений и навыков идентификации, оценки и управления рисками корпорации.   |   |                           |   |
| В процессе освоения данной дисциплины студент формирует и демонстрирует следующие |  |  |   |                           |   |
| Общепрофессиональные компетенции:   |  |  |   |                           |   |
| КОМПЕТЕНЦИИ   |  | Перечень компонентов   | Технологии формирования   | Форма оценочного средства | Уровни освоения компетенции   |
| ИНДЕКС  | ФОРМУЛИРОВКА   |  |   |                           |   |
| ОПК-3   | Способностью принимать организационно-управленческие решения | <p>Знает:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- специфику рискованной деятельности корпораций</li> <li>- особенности классификации корпоративных рисков и методы их измерения</li> <li>- методы управления корпоративными рисками</li> </ul> <p>Умеет:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- находить, распознавать и описывать природу риска</li> <li>- определять уровень риска</li> <li>- определять направления модификации риска</li> </ul> <p>Владеет:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- навыками анализа отчетности и операционной деятельности компании с целью идентификации рисков</li> <li>- навыками анализа коммерческой деятельности компании с целью анализа риска и своевременного принятия организационно-управленческого решения</li> </ul> | <p>Лекционные занятия</p> <p>Практические занятия</p> <p>Самостоятельная работа</p> | Зачет                     | <p><b>ПОРОГОВЫЙ:</b><br/>Способен анализировать влияние внешних и внутренних рисков на финансовый результат деятельности корпораций</p> <p><b>ПОВЫШЕННЫЙ:</b><br/>способен анализировать влияние внешних и внутренних рисков на финансовый результат компаний с последующим принятием организационно-управленческих решений с учетом рисков</p> |

| Профессиональные компетенции: |  |   |   |       |  |
|-------------------------------|--|---|---|-------|--|
| ПК-12                         | Способностью разрабатывать варианты управленческих решений и обосновывать их выбор на основе критериев социально-экономической эффективности | <p>Знает:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- принципы управления рисками</li> <li>- концепцию и процесс управления рисками</li> <li>- методы мониторинга и анализа принятых управленческих решений в области корпоративных рисков</li> </ul> <p>Умеет:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- количественно и качественно оценивать подверженность корпорации риску</li> <li>- строить карту рисков</li> <li>- оценивать степень риска принимаемых в корпорациях управленческих решений</li> </ul> <p>Владеет:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- навыками разработки карты рисков корпорации</li> <li>- навыками выбора метода снижения корпоративных рисков и обоснования этого выбора на основе критериев социально-экономической эффективности</li> </ul> | <p>Лекционные занятия</p> <p>Практические занятия</p> <p>Самостоятельная работа</p> | Зачет | <p><b>ПРОГОВЫЙ:</b><br/>Способен дать качественно-количественную оценку корпоративным рискам</p> <p><b>ПОВЫШЕННЫЙ:</b><br/>Способен разработать карту рисков корпорации и выбрать методы снижения этих рисков, т.е. владеет навыками разработки управленческих решений</p> |

## ОСНОВНАЯ ЧАСТЬ

### 1. ОБЪЕМ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

| Вид учебной работы  | Всего часов                           | Семестр    |            |
|---|---------------------------------------|------------|------------|
|   |                                       | 2/2        |            |
|   |                                       | часов      |            |
| 1   | 2                                     | 3          |            |
| <b>1. Контактная работа обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) (всего)</b> | <b>16</b>                             | <b>16</b>  |            |
| В том числе:  |                                       |            |            |
| Лекции (Л)  | 6                                     | 6          |            |
| Практические занятия (ПЗ), Семинары (С)   | 10                                    | 10         |            |
| Лабораторные работы (ЛР)  |                                       |            |            |
| <b>2. Самостоятельная работа магистранта (всего)</b>  | <b>88</b>                             | <b>88</b>  |            |
| В том числе   |                                       |            |            |
| <i>СРМ в семестре:</i>  |                                       |            |            |
| Курсовая работа   | КП                                    |            |            |
|   | КР                                    |            |            |
| <b>Другие виды СРМ:</b>   |                                       |            |            |
| - изучение основной и дополнительной литературы   | 44                                    | 44         |            |
| - подготовка к собеседованию  | 36                                    | 36         |            |
| - подготовка к зачету   | 8                                     | 8          |            |
| <i>СРМ в период сессии</i>  |                                       |            |            |
|   |                                       |            |            |
| Вид промежуточной аттестации  | зачет (З),<br>зачет с оценкой<br>(ЗО) | <b>4</b>   | <b>4</b>   |
|   | экзамен (Э)                           |            |            |
| ИТОГО: Общая трудоемкость   | часов                                 | <b>108</b> | <b>108</b> |
|   | зач. ед.                              | <b>3</b>   | <b>3</b>   |

Дисциплина реализуется частично с применением дистанционных образовательных технологий (Moodle, Zoom)

## 2. СОДЕРЖАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

### 2.1. Содержание разделов учебной дисциплины

| № семестра | № раздела | Наименование раздела учебной дисциплины  | Содержание раздела в дидактических единицах  |
|------------|-----------|--|--|
| 1          | 2         | 3  | 4  |
| 2/2        | 1.        | Определение риска  | Экономическая сущность и классификация финансовых рисков предприятия. Управление финансовыми рисками. Отношение к риску, владелец риска, установление контекста, внешний и внутренний контекст, источник риска, события и последствия.   |
| 2/2        | 2.        | Основные элементы процесса управления рисками                                    | Идентификация и описание риска. Базовые теории и законы рискологии. Оценка и анализ риска. Количественные и экспертные методы, их комбинирование. Принятие решения по воздействию на риск. Разработка мер контроля риска, мероприятий по управлению рисками, программы риск-менеджмента. Отчетность по управлению рисками, мониторинг и оценка эффективности процесса управления рисками.  |
| 2/2        | 3.        | Культура управления рисками  | Культура управления рисками в организации, принципы и методология изменений. Психология управления рисками. Психология принятия решений в условиях неопределенности. Работа с личностными факторами управления рисками при принятии решений и с организационной культурой  |
| 2/2        | 4.        | Управление финансовыми рисками и обеспечение финансовой безопасности предприятия | Угрозы финансовой безопасности предприятия и классификация финансовых рисков. Формирование универсальной системы управления финансовыми рисками и обеспечения финансовой безопасности предприятия. Факторы систематизации финансовых рисков угроз промышленного предприятия. Алгоритм и инструментарий управления (минимизации) финансовых рисков Оценка финансовых рисков на основе анализа финансово-хозяйственной деятельности предприятия. Оценка эффективности инвестиционных проектов с позиции риска<br>Карта рисков, методология ранжирования блоков/факторов риска, построение карты безразличия, построение кривых безразличия, идентификация риска, анализ риска, определение степени риска. Конкурентная разведка. |
| 2/2        | 5.        | Обработка риска  | Выбор опций обработки риска, подготовка и внедрение планов обработки риска, мониторинг и анализ, запись процессов риск менеджмента, методы воздействия на риск.  |

## 2.2. Разделы учебной дисциплины, виды учебной деятельности и формы контроля

| № семестра | № раздела                   | Наименование темы учебной дисциплины   | Виды учебной деятельности, включая самостоятельную работу магистрантов (в часах) |    |           |           |            |
|------------|-----------------------------|--|--|----|-----------|-----------|------------|
|            |                             |  | Л  | ЛР | ПЗ/С      | СРМ       | всего      |
| 1          | 2                           | 3  | 4  | 5  | 6         | 7         | 8          |
| 2/2        | 1.                          | Определение риска  | 0,5  |    | 0,5       | 14        | 15         |
|            | 2.                          | Основные элементы процесса управления рисками                                    | 0,5  |    | 0,5       | 14        | 15         |
|            | 3.                          | Культура управления рисками  | 1  |    | 1         | 16        | 18         |
|            | 4.                          | Управление финансовыми рисками и обеспечение финансовой безопасности предприятия | 2  |    | 4         | 22        | 28         |
|            | 5.                          | Обработка риска  | 2  |    | 4         | 22        | 28         |
|            | <b>Итого за семестр 2/2</b> |  | <b>6</b>   |    | <b>10</b> | <b>88</b> | <b>104</b> |
|            | <b>Зачет</b>                |  |  |    |           |           | <b>4</b>   |
|            | <b>ИТОГО</b>                |  |  |    |           |           | <b>108</b> |



### 3. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА МАГИСТРАНТА

#### 3.1. Виды СРМ

| № семестра              | № раздела | Наименование темы учебной дисциплины   | Виды СРМ   | Всего часов |
|-------------------------|-----------|--|--|-------------|
| 2/2                     | 1         | Определение риска  | Изучение основной и дополнительной литературы<br>Подготовка к собеседованию                        | 8<br>6      |
| 2/2                     | 2         | Основные элементы процесса управления рисками                                    | Изучение основной и дополнительной литературы<br>Подготовка к собеседованию                        | 8<br>6      |
| 2/2                     | 3         | Культура управления рисками  | Изучение основной и дополнительной литературы<br>Подготовка к собеседованию                        | 8<br>8      |
| 2/2                     | 4         | Управление финансовыми рисками и обеспечение финансовой безопасности предприятия | Изучение основной и дополнительной литературы<br>Подготовка к собеседованию                        | 12<br>10    |
| 2/2                     | 5         | Обработка риска  | Изучение основной и дополнительной литературы<br>Подготовка к собеседованию<br>Подготовка к зачету | 8<br>6<br>8 |
| <b>Итого в семестре</b> |           |  |  | <b>88</b>   |

3.2. График работы магистранта (заполняется только для очной формы обучения)

### 3.3. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

Самостоятельная работа, наряду с аудиторными занятиями, является неотъемлемой частью изучения дисциплины «Управление корпоративными рисками».

Приступая к изучению дисциплины, магистранты должны ознакомиться с учебной программой, учебной, научной и методической литературой, имеющейся в библиотеке, получить в библиотеке рекомендованные учебники и учебно-методические пособия, завести тетради для конспектирования лекций и практических занятий.

В ходе самостоятельной работы изучить основную литературу, ознакомиться с дополнительной литературой, научными статьями и материалы исследований в данной области. При этом учесть рекомендации преподавателя и требования учебной программы.

При подготовке к зачету повторять пройденный материал в строгом соответствии с учебной программой, примерным перечнем учебных вопросов, выносящихся на зачет и содержащихся в данной программе. Использовать конспект лекций и литературу, рекомендованную преподавателем. Обратит особое внимание на темы учебных занятий, пропущенных студентом по разным причинам. При необходимости обратиться за консультацией и методической помощью к преподавателю.

В процесс освоения дисциплины включаются два вида самостоятельной работы:

- аудиторная;
- внеаудиторная.

*Аудиторная самостоятельная работа* по дисциплине выполняется на учебных занятиях под непосредственным руководством преподавателя и по его заданию.

*Внеаудиторная самостоятельная работа* выполняется студентом по заданию преподавателя, но без его непосредственного участия.

Содержание внеаудиторной самостоятельной работы определяется в соответствии с рекомендуемыми видами заданий согласно рабочей программе учебной дисциплины.

Видами заданий для внеаудиторной самостоятельной работы являются:

- для овладения знаниями: чтение текста (учебника, дополнительной литературы, нормативных документов), составление плана текста, конспектирование текста, выписки из текста, учебно-исследовательская работа, использование аудио- и видеозаписей, компьютерной техники и Интернета и др.
- для закрепления и систематизации знаний: работа с конспектом лекции, обработка текста, повторная работа над учебным материалом, (составление плана, составление таблиц для систематизации учебного материала, ответ на контрольные вопросы, заполнение рабочей тетради, аналитическая обработка текста),

подготовка мультимедиа сообщений/докладов к выступлению на семинаре, подготовка реферата, тестирование и др.

- для формирования умений: решение практических ситуационных задач, решение тестов и т.д.

Самостоятельная работа может осуществляться индивидуально или группами обучающихся в зависимости от цели, объема, конкретной тематики самостоятельной работы, уровня сложности, уровня умений магистрантов.

Контроль результатов внеаудиторной самостоятельной работы обучающихся может осуществляться в пределах времени, отведенного на обязательные учебные занятия по дисциплине и внеаудиторную самостоятельную работу магистрантов по дисциплине, может проходить в письменной, устной или смешанной форме.

Для оптимизации организации и повышения качества обучения магистрантам рекомендуется руководствоваться следующими методическими рекомендациями, размещёнными на официальном сайте:

1. Мартишина Н.В. Электронный образовательный ресурс «Самостоятельная работа магистрантов»: свидетельство о регистрации ресурса № 20418 / Мартишина Н.В., Еремкина О.В.; Ряз. гос. ун-т им. С.А. Есенина. – Дата регистрации 21.10.2014.  
– Объем 196 Мб (200704 Кб).

#### **4. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ И РЕЗУЛЬТАТОВ ОСВОЕНИЯ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ (см. Фонд оценочных средств)**

**4.1. Рейтинговая система оценки знаний обучающихся по учебной дисциплине не используется**

### **5. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ**

#### **5.1. Основная литература**

| № п/п | Автор (ы), наименование, место издания и издательство, год | Используется при изучении разделов | Семестр | Количество экземпляров |            |
|-------|--|------------------------------------|---------|------------------------|------------|
|       |  |                                    |         | В библиотеке           | На кафедре |
| 1     | 2  | 3                                  | 4       | 5                      | 6          |

|    |   |     |     |     |  |
|----|---|-----|-----|-----|--|
| 1. | Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/450664">https://urait.ru/bcode/450664</a> (дата обращения: 31.08.2020). | 1-5 | 2/2 | ЭБС |  |
| 2. | Шапкин, А. С. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций: учебник / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. — 5-е изд. — Москва: Дашков и Ко, 2012. — 880 с. — Доп. Мин. образования и науки РФ. — ISBN 978-5-394-01600-4. — Текст: непосредственный.  | 1-5 | 2/2 | 50  |  |

## 5.2 Дополнительная литература

| № п/п | Автор (ы), наименование, место издания и издательство, год   | Используется при изучении разделов | Семестр | Количество экземпляров |            |
|-------|--|------------------------------------|---------|------------------------|------------|
|       |  |                                    |         | В библиотеке           | На кафедре |
| 1     | 2  | 3                                  | 4       | 5                      | 6          |
| 1.    | Гончаренко, Л. П. Риск-менеджмент: учебное пособие / Л. П. Гончаренко, С. А. Филин — Москва: КноРус, 2019. — 215 с. — (бакалавриат и магистратура). — Режим доступа: по подписке. — URL: <a href="https://book.ru/book/930474">https://book.ru/book/930474</a> (дата обращения: 12.10.2020). — ISBN 978-5-406-06784-0. — Текст: электронный. (дата обращения: 31.08.2020).     | 1-5                                | 2/2     | ЭБС                    |            |
| 2.    | Вишняков, Я. Д. Общая теория рисков: учебное пособие / Я. Д. Вишняков, Н. Н. Радаев. — 2-е изд., испр. — Москва: Академия, 2008. — 368 с. — (Высшее профессиональное образование). — Доп. УМО. - Библиогр.: с. 357-358. — ISBN 978-5-7695-5396-7. — Текст: непосредственный.   | 1-3                                | 2/2     | 10                     |            |
| 3.    | Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент: учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский; Высшая школа финансов и менеджмента Российской академии народного хозяйства и государственной службы при Президенте Российской Федерации. — Москва: Юрайт, 2016. — 353 с. — (Авторский учебник). — Рек. УМО. — Библиогр.: с. 352-353. — ISBN 978-5-9916-6469-1. — Текст: непосредственный. | 1-5                                | 2/2     | 5                      |            |
| 4.    | Круи, М. Основы риск-менеджмента: учебное пособие: пер. с англ. / М. Круи, Д. Галай, Р. Марк; научный редактор В. Б. Минасян; Высшая школа финансов и менеджмента РАНХиГС при Президенте РФ. — Москва: Юрайт, 2015. — 390 с. — ISBN 978-5-9916-3720-6. — ISBN 0-07-142966-2. — Текст : непосредственный.   | 1-5                                | 2/2     | 5                      |            |

### **5.3. Базы данных, информационно-справочные и поисковые системы:**

1. Polpred.com Обзор СМИ [Электронный ресурс]: сайт. – Доступ после регистрации из любой точки, имеющей доступ к Интернету. – Режим доступа: <http://polpred.com> (дата обращения: 21.08.2020).
2. Royal Society of Chemistry journals [Электронный ресурс]: база данных. – Доступ к полным текстам архива научных журналов из сети РГУ имени С. А. Есенина. – Режим доступа: <http://pubs.rsc.org/en/Journals?key=Title&value=Current> (дата обращения: 21.08.2020).
3. ГАРАНТ [Электронный ресурс]: справочно-правовая система. – Режим доступа: <http://www.garant.ru/>, свободный (дата обращения: 21.08.2020).
4. КОДЕКС [Электронный ресурс]: информационно-правовая система. – Режим доступа: <http://www.kodeks.ru/>, свободный (дата обращения: 21.08.2020).
5. КонсультантПлюс [Электронный ресурс]: официальный сайт. – Режим доступа: <http://www.consultant.ru>, свободный (дата обращения: 11.08.2020).
6. Научная библиотека РГУ имени С. А. Есенина [Электронный ресурс]: сайт. – Режим доступа: <http://library.rsu.edu.ru>, свободный (дата обращения: 11.08.2020).
7. Университетская библиотека ONLINE [Электронный ресурс]: электронная библиотека. – Доступ к полным текстам по паролю. – Режим доступа: <http://biblioclub.ru/> (дата обращения: 11.08.2020).
8. Электронный каталог НБ РГУ имени С. А. Есенина [Электронный ресурс]: база данных содержит сведения о всех видах литературы, поступающих в фонд НБ РГУ имени С.А. Есенина. – Рязань, 1990. – Режим доступа: <http://library.rsu.edu.ru/marc>, свободный (дата обращения: 21.08.2020).
9. Юрайт [Электронный ресурс]: электронная библиотека. – Доступ к полным текстам по паролю. – Режим доступа: <https://www.biblio-online.ru> (дата обращения: 21.08.2020).

### **5.4. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (далее – сеть «Интернет»), необходимых для освоения дисциплины:**

1. eLIBRARY.RU [Электронный ресурс]: научная электронная библиотека. – Режим доступа: <http://elibrary.ru/defaultx.asp>, свободный (дата обращения: 21.08.2020).

2. Всем, кто учится [Электронный ресурс]: образовательный сайт. – Режим доступа: <http://www.alleng.ru/>, свободный (дата обращения: 21.08.2020).

3. Министерство образования и науки РФ [Электронный ресурс]: официальный сайт. – Режим доступа: <http://минобрнауки.рф/>, свободный (дата обращения: 21.08.2020).

4. Министерство финансов РФ [Электронный ресурс]: официальный сайт. – Режим доступа: <https://www.minfin.ru/ru/>, свободный (дата обращения: 21.08.2020).

5. Российская государственная библиотека [Электронный ресурс]: официальный сайт. – Режим доступа: <https://www.rsl.ru/>, свободный (дата обращения: 21.08.2020).

6. Российская национальная библиотека [Электронный ресурс]: официальный сайт. – Режим доступа: <http://www.nlr.ru/>, свободный (дата обращения: 21.08.2020).

7. Российское образование [Электронный ресурс]: Естественно-научный образовательный портал – Режим доступа: <http://en.edu.ru>, свободный (дата обращения: 21.08.2020).

8. Межрегиональный фонд информационных технологий [Электронный ресурс]: официальный сайт. – Режим доступа: <http://www.mfit.ru/>, свободный (дата обращения: 21.08.2020).

9. Корпоративный менеджмент [Электронный ресурс]: официальный сайт. – Режим доступа: <http://www.cfin.ru>, свободный (дата обращения: 21.08.2020).

## 5.5 Периодические издания

1. Стратегические решения и риск-менеджмент – Режим доступа: по подписке. – URL: [www.jsdrm.ru](http://www.jsdrm.ru) (дата обращения: 21.08.2020).

2. Управление финансовыми рисками – Режим доступа: по подписке. – URL: <http://www.grebennikoff.ru/product/23/> (дата обращения: 21.08.2020).

3. Управление в кредитной организации – Режим доступа: по подписке. – URL: <http://www.reglament.net/bank/mng/> (дата обращения: 21.08.2020).

4. РИСК: Ресурсы, Информация, Снабжение, Конкуренция [Электронный ресурс]: сайт журнала. – Режим доступа: <http://www.risk-online.ru>, свободный (дата обращения: 21.08.2020).

## 6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1. Требования к аудиториям (помещениям, местам) для проведения занятий: Стандартно оборудованные лекционные аудитории и аудитории для проведения практических занятий.

6.2. Требования к оборудованию рабочих мест преподавателя и

обучающихся: Видеопроектор, ноутбук или стационарный компьютер или стационарный компьютер, переносной или стационарный экран. В аудиториях должны быть установлены средства LibreOffice или аналогичные.

6.3. Требования к специализированному оборудованию: отсутствуют

## **7. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ (заполняется только для ФГОС ВПО)**

## **8. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ**

| Вид учебных занятий  | Организация деятельности магистранта  |
|----------------------|---|
| Лекция               | Написание конспекта лекций: кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы, формулировки, обобщения; помечать важные мысли, выделять ключевые слова, термины. Обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, на практическом занятии. Уделить внимание следующим понятиям: карта рисков, методология ранжирования блоков/факторов риска, построение карты безразличия, построение кривых безразличия, идентификация риска, анализ риска, определение степени риска, конкурентная разведка. |
| Практические занятия | При подготовке к практическим занятиям обучающийся должен: изучить рекомендуемую литературу, необходимые нормативно-правовые документы; изучить конспекты лекций. Решение ситуационных задач: анализ отчетности и операционной деятельности компании с целью идентификации рисков, анализ коммерческой деятельности компании с целью анализа риска и своевременного принятия организационно-управленческого решения. Контроль за усвоением пройденного материала путем прохождения собеседования и тестирования.  |
| Подготовка к зачету  | При подготовке к зачету необходимо ориентироваться на конспекты лекций, материал, пройденный в рамках практических занятий, реферативный материал и рекомендуемую литературу.   |

## **9. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем**

1. Проверка домашних заданий и консультирование посредством электронной почты.
2. Использование слайд-презентаций при проведении лекционных и практических занятий.

## **10. ТРЕБОВАНИЯ К ПРОГРАММНОМУ ОБЕСПЕЧЕНИЮ УЧЕБНОГО ПРОЦЕССА**

### **Стандартный набор ПО (в компьютерных классах):**

| Название ПО                                   | № лицензии                           |
|---|--------------------------------------|
| Операционная система WindowsPro               | Договор №65/2019 от 02.10.2019       |
| Антивирус Kaspersky Endpoint Security         | Договор № 14-3К-2020 от 06.07.2020г. |
| Офисное приложение Libre Office               | Свободно распространяемое ПО         |
| Архиватор 7-zip                               | Свободно распространяемое ПО         |
| Браузер изображений Fast Stone<br>ImageViewer | Свободно распространяемое ПО         |
| PDF ридер Foxit Reader                        | Свободно распространяемое ПО         |
| Медиа проигрыватель VLC mediaplayer           | Свободно распространяемое ПО         |
| Запись дисков Image Burn                      | Свободно распространяемое ПО         |
| DJVU браузер DjVuBrowser Plug-in              | Свободно распространяемое ПО         |

### **Стандартный набор ПО (для кафедральных ноутбуков):**

| Название ПО                                   | № лицензии                           |
|---|--------------------------------------|
| Операционная система Windows <sup>1</sup>     |                                      |
| Антивирус Kaspersky Endpoint Security         | Договор № 14-3К-2020 от 06.07.2020г. |
| Офисное приложение Libre Office               | Свободно распространяемое ПО         |
| Архиватор 7-zip                               | Свободно распространяемое ПО         |
| Браузер изображений Fast Stone<br>ImageViewer | Свободно распространяемое ПО         |
| PDF ридер Foxit Reader                        | Свободно распространяемое ПО         |
| Медиа проигрыватель VLC mediaplayer           | Свободно распространяемое ПО         |
| Запись дисков Image Burn                      | Свободно распространяемое ПО         |
| DJVU браузер DjVuBrowser Plug-in              | Свободно распространяемое ПО         |

При реализации дисциплины с применением (частичным применением) дистанционных образовательных технологий используются:

- вебинарная платформа Zoom (договор б/н от 10.10.2020г.);
- система электронного обучения Moodle (свободно распространяемое ПО)

<sup>1</sup> Информация об операционной системе Windows, установленной на кафедральных ноутбуках, размещена на лицензионных наклейках на ноутбуках.



## Приложение 1

### Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

*Паспорт фонда оценочных средств по дисциплине для промежуточного контроля успеваемости*

| № п/п | Контролируемые разделы дисциплины  | Код контролируемой компетенции или её части | Наименование оценочного средства |
|-------|--|---|----------------------------------|
| 1.    | Определение риска  | ОПК-3, ПК-12                                | Зачет                            |
| 2.    | Основные элементы процесса управления рисками                                    |   |                                  |
| 3     | Культура управления рисками  |   |                                  |
| 4     | Управление финансовыми рисками и обеспечение финансовой безопасности предприятия |   |                                  |
| 5.    | Обработка риска  |   |                                  |

### ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОБУЧЕНИЯ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ

| Индекс компетенции | Содержание компетенции                                       | Элементы компетенции   | Индекс элемента |
|--------------------|--|--|-----------------|
| ОПК-3              | Способностью принимать организационно-управленческие решения | <b>знать</b>   |                 |
|                    |  | 1. специфику рисковой деятельности корпораций  | ОПК3 31         |
|                    |  | 2. особенности классификации корпоративных рисков и методы их измерения                          | ОПК3 32         |
|                    |  | 3. методы управления корпоративными рисками  | ОПК3 33         |
|                    |  | <b>уметь</b>   |                 |
|                    |  | 1. находить, распознавать и описывать природу риска  | ОПК3 У1         |
|                    |  | 2. определять уровень риска  | ОПК3 У2         |
|                    |  | 3. определять направления модификации риска  | ОПК3 У3         |
|                    |  | <b>владеть</b>   |                 |
|                    |  | 1. навыками анализа отчетности и операционной деятельности компании с целью идентификации рисков | ОПК3 В1         |

|  |  |   |         |
|--|--|---|---------|
|  |  | 2. навыками анализа коммерческой деятельности компании с целью анализа риска и своевременного принятия организационно-управленческого решения | ОПК3 В2 |
| ПК-12  | Способностью разрабатывать варианты управленческих решений и обосновывать их выбор на основе критериев социально-экономической эффективности | <b>знать</b>  |         |
|  |  | 1. принципы управления рисками  | ПК12 З1 |
|  |  | 2. концепцию и процесс управления рисками   | ПК12 З2 |
|  |  | 3. методы мониторинга и анализа принятых управленческих решений в области корпоративных рисков  | ПК12 З3 |
|  |  | <b>уметь</b>  |         |
|  |  | 1. количественно и качественно оценивать подверженность корпорации риску  | ПК12 У1 |
|  |  | 2. строить карту рисков   | ПК12 У2 |
|  |  | 3. оценивать степень риска принимаемых в корпорациях управленческих решений   | ПК12 У3 |
|  |  | <b>владеть</b>  |         |
|  |  | 1. навыками разработки карты рисков корпорации  | ПК12 В1 |
| 2. навыками выбора метода снижения корпоративных рисков и обоснования этого выбора на основе критериев социально-экономической эффективности | ПК12 В2  |   |         |

## КОМПЛЕКТ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ (зачет)

| №   | Содержание оценочного средства   | Индекс оцениваемой компетенции и ее элементов |
|-----|--|---|
| 1.  | Понятия риска и неопределенности                                       | ОПК3 31                                       |
| 2.  | Причины возникновения риска  | ОПК3 31 33                                    |
| 3.  | Внутренние и внешние факторы риска                                     | ОПК3 31                                       |
| 4.  | Понятие риск-менеджмента   | ОПК3 32                                       |
| 5.  | Отношение к риску, владелец риска                                      | ОПК3 31 ПК12 31                               |
| 6.  | Классификация риска  | ОПК3 32 33 У1                                 |
| 7.  | Система управления рисками на предприятии.                             | ОПК3 33 33 В1 В2 ПК12 31 32 33                |
| 8.  | Определение критериев риска  | ОПК3 31 У1 У2 В1 В2 ПК12 33 У3                |
| 9.  | Оценка риска.  | ОПК3 В2 ПК12 33 У1 У3                         |
| 10. | Принципы управления рисками  | ОПК3 33 33 У2 ПК12 31 32 У3                   |
| 11. | Концепция риск-менеджмента   | ОПК3 31 33 ПК12 32 У2 У3 В1                   |
| 12. | Внедрение риск-менеджмента   | ОПК3 31 33 ПК12 У2 В1                         |
| 13. | Методы оценки рисков   | ОПК3 В2 ПК12 33 У1 У3                         |
| 14. | Диагностика рисков   | ОПК3 В2 ПК12 33 У1 У3                         |
| 15. | Методология ранжирования блоков/факторов риска                         | ОПК3 У2 В1 В2 ПК12 У1                         |
| 16. | Построение кривых безразличия  | ОПК3 У2 ПК12 33 У1                            |
| 17. | Методы воздействия на риск   | ОПК3 33                                       |
| 18. | Риски организационной структуры управления                             | ОПК3 33 У2 ПК12 33 У1                         |
| 19. | Оценка и прогнозирование риска   | ОПК3 33 В2 ПК12 32 У1                         |
| 20. | Концепция рисковой стоимости VaR                                       | ОПК3 33 В2 ПК12 32 У1                         |
| 21. | Взаимосвязь рыночного равновесия на изменение коммерческого риска.     | ОПК3 У2 В1 В2 ПК12 У1                         |
| 22. | Влияние факторов рыночного равновесия на изменение коммерческого риска | ОПК3 У2 В1 В2 ПК12 У1                         |
| 23. | Связь финансового и операционного рычага с совокупным риском           | ОПК3 33 В1 В2 ПК12 У1                         |
| 24. | Управление рыночными рисками   | ОПК3 33 ПК12 31 33 У1 У3 В2                   |
| 25. | Управление риском ликвидности  | ОПК3 33 ПК12 31 33 У1 У3 В2                   |
| 26. | Управление кредитными рисками  | ОПК3 33 ПК12 31 33 У1 У3 В2                   |
| 27. | Профилактика кредитных рисков  | ОПК3 33 ПК12 31 33 У1 У3 В2                   |
| 28. | Управление операционными рисками                                       | ОПК3 33 ПК12 31 33 У1 У3 В2                   |
| 29. | Управление рисками внешней среды                                       | ОПК3 33 ПК12 31 33 У1 У3 В2                   |
| 30. | Модификация рисков   | ОПК3 У3 ПК12 В2                               |

## ПОКАЗАТЕЛИ И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

(Шкалы оценивания)

Результаты выполнения обучающимся заданий на зачете оцениваются по шкале «зачтено» - «не зачтено».

В основе оценивания лежат критерии порогового и повышенного уровня характеристик компетенции, формируемой на учебных занятиях по дисциплине «Управление корпоративными рисками» (Таблица 2.5 рабочей программы дисциплины).

| <b>Результат зачета</b> | <b>Критерии</b>  |
|-------------------------|--|
| «зачтено»               | Обучающийся достиг порогового уровня, показал знания основных положений учебной дисциплины, умение решать конкретные практические задачи   |
| «не зачтено»            | обучающийся не достиг порогового уровня, демонстрирует непонимание проблемы, не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические работы |

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ  
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ  
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
«РЯЗАНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ИМЕНИ С.А. ЕСЕНИНА»

Утверждаю:  
Декан факультета экономики

 В.С. Отто

«31» августа 2020 г.

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

**Управление корпоративными рисками**

Уровень основной профессиональной образовательной программы: *магистратура*

Направление подготовки: *38.04.01 Экономика*

Направленность (профиль) подготовки *Финансовая экономика*

Форма обучения: *заочная*

Сроки освоения ОПОП: *нормативный, 2,5 года*

Факультет: *экономики*

Кафедра: *бухгалтерского учета, налогообложения и экономического анализа*

Рязань, 2020

## **1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ**

Целью изучения дисциплины является формирование у обучающихся компетенций, обеспечивающих получение профессиональных умений и навыков идентификации, оценки и управления рисками корпорации.

## **2. МЕСТО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП**

Учебная дисциплина «Управление корпоративными рисками» относится к дисциплинам по выбору вариативной части Блока 1.

3. Трудоемкость дисциплины: 3 зачетные единицы, 108 академических часа.

5. Форма промежуточной аттестации и семестр (ы) прохождения  
Зачет (1 курс, сессия 3).

Дисциплина реализуется частично с применением дистанционных образовательных технологий.

#### 4. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения основной профессиональной образовательной программы

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся общепрофессиональных (ОПК) и профессиональных (ПК) компетенций:

| № п/п | Номер/индекс компетенции | Содержание компетенции (или ее части)  | Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине<br>В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны:  |   |   |
|-------|--------------------------|--|--|---|---|
|       |                          |  | Знать  | Уметь   | Владеть   |
| 1     | 2                        | 3  | 4  | 5   | 6   |
| 1.    | ОПК-3                    | Способностью принимать организационно-управленческие решения   | <ul style="list-style-type: none"> <li>- специфику рисков деятельности корпораций</li> <li>- особенности классификации корпоративных рисков и методы их измерения</li> <li>- методы управления корпоративными рисками</li> </ul>         | <ul style="list-style-type: none"> <li>- находить, распознавать и описывать природу риска</li> <li>- определять уровень риска</li> <li>- определять направления модификации риска</li> </ul>  | <ul style="list-style-type: none"> <li>- навыками анализа отчетности и операционной деятельности компании с целью идентификации рисков</li> <li>- навыками анализа коммерческой деятельности компании с целью анализа риска и своевременного принятия организационно-управленческого решения</li> </ul> |
| 2.    | ПК-12                    | Способностью разрабатывать варианты управленческих решений и обосновывать их выбор на основе критериев социально-экономической эффективности | <ul style="list-style-type: none"> <li>- принципы управления рисками</li> <li>- концепцию и процесс управления рисками</li> <li>- методы мониторинга и анализа принятых управленческих решений в области корпоративных рисков</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>- количественно и качественно оценивать подверженность корпорации риску</li> <li>- строить карту рисков</li> <li>- оценивать степень риска принимаемых в корпорациях управленческих решений</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>- навыками разработки карты рисков корпорации</li> <li>- навыками выбора метода снижения корпоративных рисков и обоснования этого выбора на основе критериев социально-экономической эффективности</li> </ul>  |